

MÉTODOS DE COMPARAÇÃO DE SÉRIES TEMPORAIS

Gladys Elena Salcedo Echeverry
Universidad del Quindio – Colombia

Clélia Maria de Castro Toloí

Departamento de Estatística, Universidade de São Paulo

Na análise de séries temporais, muitas vezes, é de interesse verificar se duas séries, ou trechos de uma mesma série, estão sendo gerados pelo mesmo processo estocástico. No caso de processos estocásticos estacionários de 2ª ordem, as hipóteses de interesse são verificar se elas apresentam igual estrutura de autocovariância (autocorrelação) ou igualdade das funções densidades espectrais.

Neste trabalho apresentamos vários testes abordados por Quenouille [*Journal Royal Statist. Soc.*, **B 20**(1) (1958) : 158-164], Coates e Diggle [*Journal of Time Series Analysis* , **7**(1) (1986) : 7-20], Mélard e Roy [*La Revue Cadadienne de Statistique* **12**(4) (1984) : 333-342] e Carmona e Wang [*Stochastic Modelling in Physical Oceanography* **39**(1) (1996) : 69-88], este último adequado para comparação de séries multivariadas.

Finalmente, fazemos uma aplicação utilizando uma série bivariada de temperatura e salinidade, medidas na superfície e no fundo da água, na estação de monitoramento denominada “Boca de Cano Grande da Ciénaga Grande de Santa Marta “ na Colombia.

Endereço para correspondência : Gladys Elena Salcedo E., Universidad del Quindio – Colombia, e-mail: gsalcedo@quimbaya.uniquindio.edu.co